

東京海上・気候変動対応 株式ファンド (為替ヘッジあり)

＜愛称 グリーンフューチャー＞

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／株式 (課税上は株式投資信託として取扱われます。)	
信託期間	2021年10月4日から2031年8月8日	
運用方針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。原則として、為替ヘッジを行うことにより、為替変動リスクの低減を図ります。	
主要投資対象	東京海上・気候変動対応株式ファンド(為替ヘッジあり)	「東京海上・気候変動対応株式マザーファンド」を主要投資対象とします。
	東京海上・気候変動対応株式マザーファンド	日本を含む世界の取引所に上場されている株式(これに準ずるものを含みます。)を主要投資対象とします。
投資制限	東京海上・気候変動対応株式ファンド(為替ヘッジあり)	<ul style="list-style-type: none"> 株式への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	東京海上・気候変動対応株式マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	<p>毎決算時に、原則として経費控除後の、繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。</p> <p>収益の分配に充当せず、信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。</p>	

第4期 運用報告書(全体版)

(決算日 2023年8月10日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。
さて、「東京海上・気候変動対応株式ファンド(為替ヘッジあり)＜愛称 グリーンフューチャー＞」は、このたび、第4期の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

東京都千代田区丸の内1-8-2 鉄鋼ビルディング

お問い合わせ窓口

東京海上アセットマネジメント サービスデスク 0120-712-016

受付時間：営業日の9時～17時

<https://www.tokiomarineam.co.jp/>

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○設定以来の運用実績

決算期	基準 (分配落)	基準価額			株式 組入比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
		税金 分	込 配	騰 落 率			
(設定日)	円		円		%	%	百万円
2021年10月4日	10,000		—	—	—	—	250
1期(2022年2月10日)	9,906		0	△0.9	87.7	4.5	2,235
2期(2022年8月10日)	9,505		0	△4.0	90.6	4.2	2,052
3期(2023年2月10日)	9,717		0	2.2	89.3	6.0	2,051
4期(2023年8月10日)	9,522		0	△2.0	91.7	5.3	1,894

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準	基準価額		株式 組入比率	投資信託 組入比率	証券 組入比率
		騰 落	率			
(期首)	円		%	%	%	%
2023年2月10日	9,717		—	89.3		6.0
2月末	9,546		△1.8	91.7		5.8
3月末	9,403		△3.2	89.4		5.1
4月末	9,303		△4.3	91.9		5.3
5月末	9,189		△5.4	92.0		5.0
6月末	9,662		△0.6	92.7		5.6
7月末	9,869		1.6	88.3		5.2
(期末)						
2023年8月10日	9,522		△2.0	91.7		5.3

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

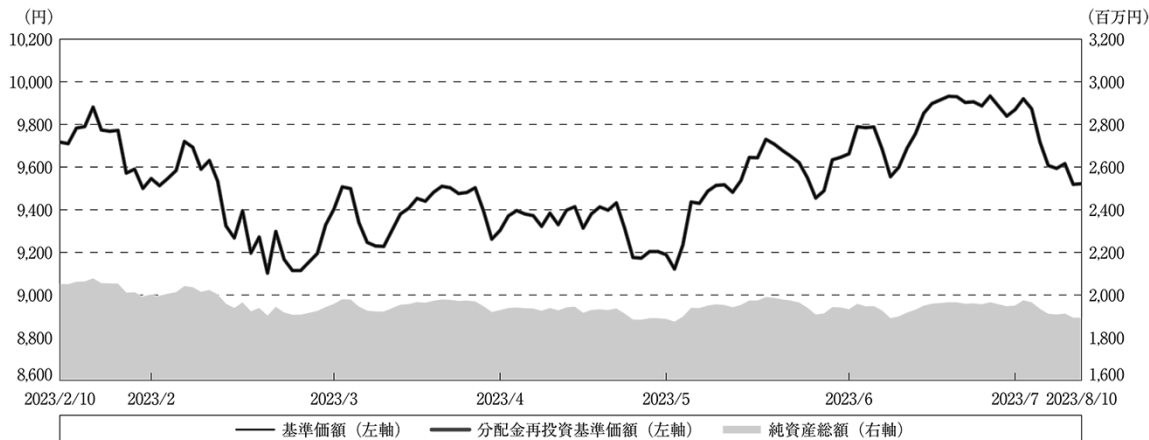
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

当ファンドにベンチマークはなく、また当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる指数もないため、ベンチマーク、参考指数を記載していません。

○運用経過

(2023年2月11日～2023年8月10日)

■期中の基準価額等の推移



(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額は、期首(2023年2月10日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・米国でインフレ進行の一服感から金融引き締めペースの減速に対する期待が高まる場面があったこと

マイナス要因

- ・インフレ懸念の高まりを背景に、欧米の中央銀行が金融引き締めを継続したこと
- ・為替ヘッジなどのコスト

■投資環境

当期、世界株式市場は上昇しました。ロシアによるウクライナ侵攻の長期化やそれを受けたインフレ高進を背景とした欧米の中央銀行の金融引き締め継続といった環境に大きな変化はなかったものの、米国でインフレ進行の一服感を示す指標が開始したことで、金融引き締めペースの減速に対する期待が高まり、株式市場は堅調な展開となりました。一部のハイテク関連銘柄で事前予想を上回る決算が発表されるなど、ハイテク関連企業を中心に業績の回復が見られたことも株式市場のサポート材料となりました。

■ポートフォリオについて

<東京海上・気候変動対応株式ファンド(為替ヘッジあり)>

「東京海上・気候変動対応株式マザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持しました。また、マザーファンドの通貨ウェイトに応じて対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。

当ファンドの基準価額は、2.0%下落しました。

<東京海上・気候変動対応株式マザーファンド>

気候変動への対応に積極的に取り組む企業（気候変動の影響を「緩和」する、または気候変動の影響に「適応」する事業を行う企業）の株式等に投資を行いました。

「気候変動に強いインフラ」をテーマとする米国の保険リスク分析会社VERISK ANALYTICS INCの株価上昇はプラス寄与した一方、「低炭素電力」をテーマとする中国の風力発電会社CHINA LONGYUAN POWER GROUPの株価下落はマイナス寄与となりました。

以上のような運用の結果、円安の進行などを主因に、基準価額は10.2%上昇しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けていません。

また、当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる参考指数もないため、記載する事項はありません。

■分配金

当期においては、基準価額の水準や運用の効率性などを勘案して、収益分配を行わないこととしました。なお、収益分配に充てなかった収益については信託財産内に留保し、当ファンドの運用方針に基づいて運用を行います。

◇分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第4期
	2023年2月11日～ 2023年8月10日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	89

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

〈東京海上・気候変動対応株式ファンド(為替ヘッジあり)〉

「東京海上・気候変動対応株式マザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持します。また、マザーファンドの通貨ウェイトに応じて対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。

〈東京海上・気候変動対応株式マザーファンド〉

引き続き、気候変動の影響を緩和する(温室効果ガスの排出を抑制する)事業を行う企業、または気候変動の影響に適応する(気候変動の影響による被害を回避・軽減する)事業を行う企業といった、気候変動への対応に積極的に取り組む企業に投資を行います。

今後も、製品やサービスなどを通じて環境の持続可能性や気候変動リスクに直接的に対応している企業の発掘に努めます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年2月11日～2023年8月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	87	0.914	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(49)	(0.518)	*委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価
（ 販 売 会 社 ）	(36)	(0.382)	*購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
（ 受 託 会 社 ）	(1)	(0.014)	*運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	2	0.017	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数
（ 株 式 ）	(2)	(0.017)	*売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.008	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数
（ 株 式 ）	(1)	(0.008)	*有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	2	0.019	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(1)	(0.013)	*保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(1)	(0.005)	*監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	92	0.958	
期中の平均基準価額は、9,495円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

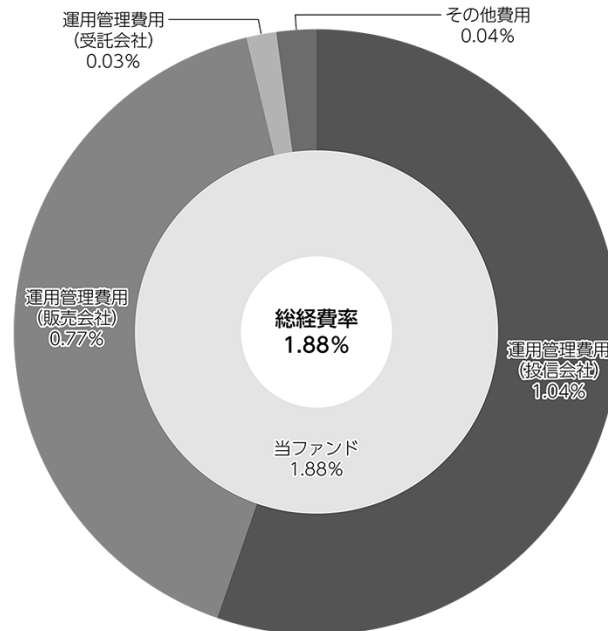
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.88%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2023年2月11日～2023年8月10日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
東京海上・気候変動対応株式マザーファンド		千口 88,975	千円 109,509	千口 346,504	千円 429,623

○株式売買比率

(2023年2月11日～2023年8月10日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	東京海上・気候変動対応株式マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	7,653,420千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	8,915,385千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.85	

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2023年2月11日～2023年8月10日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2023年8月10日現在)

親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
東京海上・気候変動対応株式マザーファンド		千口 1,756,928	千口 1,499,399	千円 1,947,570

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2023年8月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
東京海上・気候変動対応株式会社マザーファンド	1,947,570	99.1
コール・ローン等、その他	17,995	0.9
投資信託財産総額	1,965,565	100.0

(注) 東京海上・気候変動対応株式会社マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(8,797,729千円)の投資信託財産総額(9,939,709千円)に対する比率は88.5%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=143.96円、1ユーロ=157.97円、1英ポンド=183.06円、1スウェーデンクローナ=13.50円、1デンマーククローネ=21.20円、1香港ドル=18.41円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年8月10日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,734,480,337
東京海上・気候変動対応株式会社マザーファンド(評価額)	1,947,570,266
未収入金	1,786,910,071
(B) 負債	1,840,272,622
未払金	1,822,306,664
未払信託報酬	17,859,429
その他未払費用	106,529
(C) 純資産総額(A-B)	1,894,207,715
元本	1,989,223,320
次期繰越損益金	△ 95,015,605
(D) 受益権総口数	1,989,223,320口
1万口当たり基準価額(C/D)	9.522円

(注) 当ファンドの期首元本額は2,111,815,186円、期中追加設定元本額は35,079,670円、期中一部解約元本額は157,671,536円です。

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2023年2月11日～2023年8月10日)

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	△ 20,416,136
売買益	297,537,409
売買損	△317,953,545
(B) 信託報酬等	△ 17,965,958
(C) 当期損益金(A+B)	△ 38,382,094
(D) 前期繰越損益金	△115,375,190
(E) 追加信託差損益金	58,741,679
(配当等相当額)	(1,718,876)
(売買損益相当額)	(57,022,803)
(F) 計(C+D+E)	△ 95,015,605
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	△ 95,015,605
追加信託差損益金	58,741,679
(配当等相当額)	(1,756,261)
(売買損益相当額)	(56,985,418)
分配準備積立金	16,071,891
繰越損益金	△169,829,175

(注) (A) 有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (B) 信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (E) 追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

(注) 信託財産の運用指図に係る権限の全部または一部を委託するために要した費用として、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対して年1万分の60の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しています。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	3,575,851円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	1,756,261円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	12,496,040円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	17,828,152円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	89円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

東京海上・気候変動対応株式マザーファンド

運用報告書 第2期（決算日 2023年8月10日）

（計算期間 2022年8月11日～2023年8月10日）

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		株 組 入 比	式 率	投 資 信 託 組 入 比	純 資 産 額
	騰 落	率				
(設定日) 2021年10月4日	円 10,000	% —		% —	% —	百万円 500
1期(2022年8月10日)	11,403	14.0		91.1	4.2	10,766
2期(2023年8月10日)	12,989	13.9		89.1	5.2	9,483

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		株 組 入 比	式 率	投 資 信 託 組 入 比
	騰 落	率			
(期 首) 2022年8月10日	円 11,403	% —		% 91.1	% 4.2
8月末	11,546	1.3		87.6	4.0
9月末	10,926	△ 4.2		90.1	3.5
10月末	11,855	4.0		89.7	3.9
11月末	11,795	3.4		90.2	5.0
12月末	11,176	△ 2.0		89.1	5.3
2023年1月末	11,539	1.2		89.6	6.0
2月末	11,986	5.1		87.8	5.5
3月末	11,687	2.5		90.0	5.1
4月末	11,686	2.5		90.0	5.2
5月末	11,996	5.2		91.4	5.0
6月末	13,136	15.2		88.4	5.3
7月末	13,192	15.7		88.8	5.3
(期 末) 2023年8月10日	12,989	13.9		89.1	5.2

(注) 騰落率は期首比です。

当ファンドにベンチマークはなく、また当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる指数もないため、ベンチマーク、参考指数を記載していません。

○運用経過

(2022年8月11日～2023年8月10日)

■期中の基準価額等の推移

期首：11,403円

期末：12,989円

騰落率：13.9%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・米国でインフレ進行の一服感から金融引き締めペースの減速に対する期待が高まる場面があったこと
- ・円安が進行したこと

マイナス要因

- ・インフレ懸念の高まりを背景に、欧米の中央銀行が金融引き締めを継続したこと



■投資環境

【世界株式市場】

当期、世界の株式市場は上昇しました。期初は、引き続き高いインフレ率を受けて、エネルギーなどコモディティ価格の上昇がコスト増加として企業決算のマイナス要因となったことや、インフレの高進に対して欧米の中央銀行が積極的な金融引き締めを継続するなかで、景気の先行き懸念が高まり世界の株式市場は下落基調となりました。その後は、米国のインフレ指標が落ち着いた動きとなったことでインフレのピークアウト観測から金融引き締めペースの減速に対する期待が高まったことから、世界の株式市場は反発上昇し、期末にかけて堅調に推移しました。

【為替市場】

米ドル円為替レートは円安米ドル高となりました。期初は、日銀が金融緩和姿勢を維持した一方で、FRB（米連邦準備制度理事会）の積極的な金融引き締めにより米国金利は上昇傾向となり、日米の金利差を背景に円安米ドル高が進行しました。その後は、インフレのピークアウト観測から金融引き締めペースの減速に対する期待が高まり、一転して円高米ドル安の流れとなりました。しかし、インフレ基調の継続から、改めて金利の先高観が高まると再び円安米ドル高の流れとなりました。日銀による長期金利の許容変動幅の柔軟化を受けた円高の進行なども一時的な動きに留まりました。

ユーロ円為替レートは円安ユーロ高となりました。期初は、ECB（欧州中央銀行）による積極的な金融引き締め政策による日本との金利差拡大を背景に円安ユーロ高が進行しました。その後は、欧州でもインフレのピークアウトへの期待から金利が低下基調となり、円高ユーロ安となりましたが、インフレ懸念に再び焦点が集まったことに加え、ユーロ圏のGDP（国内総生産）が予想を上回ると景気回復への期待が高まり円安ユーロ高の流れが強まりました。

■ポートフォリオについて

気候変動への対応に積極的に取り組む企業（気候変動の影響を「緩和」する、または気候変動の影響に「適応」する事業を行う企業）の株式等に投資を行いました。

「低炭素電力」をテーマとする米国の薄膜太陽電池モジュール製造・販売会社FIRST SOLAR INCの株価上昇はプラス寄与となった一方、「エネルギー効率化」をテーマとする気候変動対策への投資に注力する米国のHANNON ARMSTRONG SUSTAINABLEの株価下落はマイナス寄与となりました。

以上のような運用の結果、当マザーファンドが保有する株式の上昇や円安の進行などがプラスに寄与し、基準価額は13.9%上昇しました。

○今後の運用方針

引き続き、気候変動の影響を緩和する（温室効果ガスの排出を抑制する）事業を行う企業、または気候変動の影響に適応する（気候変動の影響による被害を回避・軽減する）事業を行う企業といった、気候変動への対応に積極的に取り組む企業に投資を行います。

今後も、製品やサービスなどを通じて環境の持続可能性や気候変動リスクに直接的に対応している企業の発掘に努めます。

○1万口当たりの費用明細

(2022年8月11日～2023年8月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	円 4 (3) (0)	% 0.030 (0.029) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 * 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	2 (2) (0)	0.019 (0.019) (0.000)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 * 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	3 (3) (0)	0.022 (0.022) (0.000)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 * 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 * その他は、信託事務等に要する諸費用
合 計	9	0.071	
期中の平均基準価額は、11,876円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

(2022年8月11日～2023年8月10日)

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国内	上場	千株 104	千円 557,456	千株 84	千円 576,707
	アメリカ	百株 4,423	千米ドル 28,075	百株 5,588	千米ドル 49,250
外	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	456	1,786	87	1,571
	フランス	481	1,673	303	1,252
	イギリス	346	千英ポンド 392	1,047	千英ポンド 1,177
国	スウェーデン	929	千スウェーデンクローナ 10,902	699	千スウェーデンクローナ 8,071
	デンマーク	652	千デンマーククローネ 13,019	622	千デンマーククローネ 11,715
	香港	11,608	千香港ドル 25,382	4,015	千香港ドル 4,885

(注) 金額は受渡代金です。

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	HANNON ARMSTRONG SUSTAINABLE	11,942	375	9,861	284
	WEYERHAEUSER CO	43,541	1,381	21,666	694
国	小計	55,483	1,757	31,527	978

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

○株式売買比率

(2022年8月11日～2023年8月10日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当	期
(a) 期中の株式売買金額		14,318,778千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額		9,073,833千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)		1.57

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2022年8月11日～2023年8月10日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2023年8月10日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
機械 (72.6%)			
クボタ	78.7	125.2	281,887
ダイキン工業	—	7.6	192,812
電気機器 (27.4%)			
日立製作所	32.8	19.4	178,906

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
陸運業 (—%)			
東日本旅客鉄道	20.6	—	—
合 計	株 数 ・ 金 額	132	152 653,606
	銘柄数<比率>	3	3 <6.9%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

外国株式

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株数	評 価 額		業 種 等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
ACUTY BRANDS INC	119	46	764	110,104	資本財	
AECOM	442	136	1,169	168,359	資本財	
ALBEMARLE CORP	—	66	1,300	187,191	素材	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	190	110	1,553	223,664	公益事業	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	—	56	484	69,766	食品・飲料・タバコ	
AVANGRID INC	194	—	—	—	公益事業	
AZEK CO INC/THE	—	784	2,609	375,611	資本財	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	—	297	1,424	205,118	ソフトウェア・サービス	
CONSOLIDATED EDISON INC	324	158	1,441	207,497	公益事業	
DARLING INGREDIENTS INC	261	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
DEERE & CO	46	33	1,471	211,818	資本財	
ASPEN TECHNOLOGY INC	86	89	1,680	241,956	ソフトウェア・サービス	
EVERSOURCE ENERGY	341	174	1,176	169,378	公益事業	
EXELON CORP	759	309	1,247	179,521	公益事業	
FMC CORP	225	64	559	80,536	素材	
FIRST SOLAR INC	383	76	1,547	222,757	半導体・半導体製造装置	
GENERAC HOLDINGS INC	—	108	1,157	166,586	資本財	
GREEN PLAINS INC	354	201	680	97,962	エネルギー	
HUBBELL INC	30	22	697	100,416	資本財	
MSCI INC	—	6	381	54,963	金融サービス	
MOODY'S CORP	105	28	961	138,440	金融サービス	
ON SEMICONDUCTOR CORP	—	241	2,394	344,656	半導体・半導体製造装置	
S&P GLOBAL INC	97	57	2,244	323,125	金融サービス	
SMITH (A. O.) CORP	—	355	2,584	372,041	資本財	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	54	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
TRIMBLE INC	—	109	597	86,067	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
VERISK ANALYTICS INC	200	66	1,553	223,576	商業・専門サービス	
WABTEC CORP/DE	356	212	2,426	349,291	資本財	
WASTE MANAGEMENT INC	189	74	1,195	172,139	商業・専門サービス	
WESCO INTERNATIONAL INC	—	42	636	91,586	資本財	
WOLFSPEED INC	184	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	—	213	1,423	204,908	ソフトウェア・サービス	
APTIV PLC	196	158	1,651	237,733	自動車・自動車部品	
EATON CORP PLC	55	—	—	—	資本財	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	—	64	1,302	187,466	資本財	
ATLANTICA SUSTAINABLE INFRAS	101	—	—	—	公益事業	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	230	—	—	—	資本財	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,535 25	4,370 30	40,318 —	5,804,244 <61.2%>	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	30	—	—	—	保険	
SIEMENS AG	133	127	1,871	295,606	資本財	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	—	405	1,371	216,666	資本財	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	164 2	533 2	3,242 —	512,273 <5.4%>	
(ユーロ…フランス)						
VEOLIA ENVIRONNEMENT	448	559	1,554	245,532	公益事業	

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN		213	280	1,708	269,828	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	661	839	3,262	515,360	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 5.4% >	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	825	1,372	6,505	1,027,634	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 10.8% >	
(イギリス)				千英ポンド		
PERSIMMON PLC		855	214	240	44,080	耐久消費財・アパレル
NATIONAL GRID PLC		1,128	1,067	1,043	190,945	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	1,983	1,282	1,283	235,026	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 2.5% >	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
HEXAGON AB-B SHS		960	1,190	12,144	163,957	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小 計	株 数 ・ 金 額	960	1,190	12,144	163,957	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 1.7% >	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		445	476	8,363	177,305	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	445	476	8,363	177,305	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 1.9% >	
(香港)				千香港ドル		
BYD CO LTD		—	483	12,524	230,575	自動車・自動車部品
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H		5,529	12,639	8,809	162,182	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	5,529	13,122	21,333	392,757	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	2	—	< 4.1% >	
合 計	株 数 ・ 金 額	15,280	21,814	—	7,800,925	
	銘 柄 数 < 比 率 >	34	40	—	< 82.3% >	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

(注) 小計、合計欄の < > 内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

外国投資信託証券

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末		比 率	
		口 数	口 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		口	口	千米ドル	千円	%
HANNON ARMSTRONG SUSTAINABLE		29,495	31,576	709	102,095	1.1
WEYERHAEUSER CO		59,040	80,915	2,702	389,060	4.1
合 計	口 数 ・ 金 額	88,535	112,491	3,411	491,156	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 5.2% >	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

○投資信託財産の構成

(2023年8月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	8,454,532	85.1
投資証券	491,156	4.9
コール・ローン等、その他	994,021	10.0
投資信託財産総額	9,939,709	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産(8,797,729千円)の投資信託財産総額(9,939,709千円)に対する比率は88.5%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=143.96円、1ユーロ=157.97円、1英ポンド=183.06円、1スウェーデンクローナ=13.50円、1デンマーククローネ=21.20円、1香港ドル=18.41円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年8月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	10,270,829,104
コール・ローン等	613,002,970
株式(評価額)	8,454,532,147
投資証券(評価額)	491,156,675
未収入金	695,082,322
未収配当金	17,054,990
(B) 負債	787,036,345
未払金	489,546,032
未払解約金	297,489,563
未払利息	750
(C) 純資産総額(A-B)	9,483,792,759
元本	7,301,316,050
次期繰越損益金	2,182,476,709
(D) 受益権総口数	7,301,316,050口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,989円

(注) 当親ファンドの期首元本額は9,442,012,260円、期中追加設定元本額は980,815,526円、期中一部解約元本額は3,121,511,736円です。

<元本の内訳>

東京海上・気候変動対応株式ファンド(為替ヘッジなし) 5,801,916,353円
東京海上・気候変動対応株式ファンド(為替ヘッジあり) 1,499,399,697円

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況

(2022年8月11日~2023年8月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	177,486,732
受取配当金	164,480,563
受取利息	13,088,536
その他収益金	3
支払利息	△ 82,370
(B) 有価証券売買損益	1,174,457,785
売買益	2,178,207,140
売買損	△1,003,749,355
(C) 保管費用等	△ 2,259,239
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,349,685,278
(E) 前期繰越損益金	1,324,315,107
(F) 追加信託差損益金	175,277,414
(G) 解約差損益金	△ 666,801,090
(H) 計(D+E+F+G)	2,182,476,709
次期繰越損益金(H)	2,182,476,709

(注) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (F)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

(注) (G)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。